

上海证券交易所技术文档



港股通
市场参与者接口规格说明书
(1.06 版)
(港股交易)



上海证券交易所

二〇二〇年七月

发布说明

本文档为市场参与者通过 EzSTEP 接入上交所港股通系统的接口规格。

本文档定义了上交所港股交易业务市场参与者 EzSTEP 接口。

本文档由上海证券交易所起草，并负责进行解释。

文档变更 20131014:

- 1、初稿。

文档变更 20140318:

- 1、删除修改单，增加港股基础信息接口。

文档变更 20140324:

- 1、修改港股基础信息接口结构。

文档变更 20140326:

- 1、修改港股基础信息，增加可交易标识。

文档变更 20140405:

- 1、增加转发的最小价差文件格式。

文档变更 20140425:

- 1、增加实时行情。

文档变更 20140425:

- 1、增加额度信息，增加实时行情接口规格。增加自动撤单。

文档变更 20140519:

- 1、修订实时行情接口。

文档变更 20140523

- 1、补充 reff04 文件接口说明。
- 2、删除 reff04 中汇率。
- 3、补充转发独立的汇率文件。
- 4、补充说明申报的证券代码在 5 位代码基础上补位为 6 位。
- 5、补充说明申报结算代码用于预留。

文档变更 20140618

- 1、删除公共数据表额度发布，增加实时交易盘状态文件，其中包含实时额度和港股通证券交易实时状态。补充关于港股行情的说明。

文档变更 20140618

- 1、增加盘后成交单据文件。
- 2、交易盘实时状态增加港股通交易日状态。
- 3、交易盘实时状态增加区分整手、零股订单可买卖状态。

文档变更 20140714

- 1、修改港股基础信息文件 reff040 中产品状态信息，删除可买卖标识，具体标的可买卖标识参考港股通交易盘实时状态 trdses04.txt 接口。
- 2、港股执行报告接口中成交编号字段不止 10 位，修改描述。
- 3、补充说明港股通不支持 FOK 订单。

文档变更 20140728

- 1、补充行情接口 mkttdt04.txt 部分字段集合竞价时段内价量字段的描述，补充各字段与 MMDH 商业行情对应的说明供参考。
- 2、根据港交所要求修改成交单据 tjss04XXXXX.txt “说明” 字段描述，增加字段长度。

文档变更 20140813

- 1、根据港交所要求修改成交单据 tjss04XXXXX.txt “说明 2” “说明 3” 字段内容。
- 2、新增加余额对账文件接口，以便于支持拆分合并业务。
- 3、因 rptget 文件名长度限制，更改压缩后的成交单据、余额对账文件名。

文档变更 20140930

- 1、根据港交所要求修改成交单据 tjss04XXXXX.txt 说明字段内容。
- 2、补充行情汉字编码说明。补充说明余额对账文件的使用，补充说明额度相关字段。

文档变更 20160227

- 1、港股通行情文件 mkttdt04.txt 加入市调机制（VCM）及收市竞价交易时段（CAS）相关的行情信息。
- 2、港股基础信息文件 reff04MMDD.txt 增加对 VCM 和 CAS 的支持。
- 3、市场接口联系人修订。

文档变更 20160506

- 1、在申报响应消息和执行报告消息说明中增加港交所错误信息说明
- 2、在申报撤单失败响应消息中增加备注字段以及港交所错误信息说明

文档变更 20191206

- 1、补充关于港股实时行情 `mktdt04.txt` 文件的使用约束。
- 2、调整港股实时行情 `mktdt04.txt` 文件发送时间及内容相关表述。
- 3、删除港股通余额对账文件 `hold04XXXXX.txt` 相关描述。
- 4、其他文字描述调整。

本次修订均为文字性描述调整，不涉及系统技术变更。

文档变更 20200703

- 1、港股实时行情 `mktdt04.txt` 加入开市前时段优化的行情信息。
- 2、港股基础信息 `reff04MMDD.txt` 加入开市前时段优化的信息。

服务电话：021-4009003600

通信地址：上海市浦东南路 528 号上海证券交易所技术公司技术开发总部

网站地址：<http://www.sse.com.cn/> → 交易技术支持专区

目录

1 数据格式、STEP 消息约定及通用数据库接口规范	6
2 港股交易业务消息规范.....	7
2.1.....港股交易业务 STEP 消息流程图	7
2.2.....申报消息	7
2.3.....申报撤单消息	9
2.4.....申报响应消息/申报撤单成功响应消息	10
2.5.....申报撤单失败响应消息.....	11
2.6.....执行报告消息	12
3 过户数据接口 hghXXXXX.dbf	14
4 港股通成交单据文件 tjss04XXXXX.txt.....	16
5 港股实时行情 mkttdt04.txt（转发）	17
5.1.....结构描述	19
5.2.....格式定义	19
附录一：市场状态取值说明.....	28
附录二：港股相关交易信息用户约束	30
6 港股通交易盘实时状态 trdses04.txt.....	31
6.1.....格式定义	31
7 港股基础信息 reff04MMDD.txt（转发）	35
8 港股通参考汇率文件 extra04MMDD.txt（转发）	38
9 最小价差文件 zxjcMMDD.txt（转发）	39
10 后记	41

1 数据格式、STEP 消息约定及通用数据库接口规范

数据格式约定参见《上海证券交易所市场参与者 EzSTEP 通用数据库接口规格说明书》。

STEP 消息约定参见《上海证券交易所市场参与者 EzSTEP 通用数据库接口规格说明书》。

通用数据库接口参见《上海证券交易所市场参与者 EzSTEP 通用数据库接口规格说明书》。

撮合业务支持以下请求业务类型编号（reqid），取值：

HKN 港股订单申报（HongKong New entry），即港股整手订单

HKO 港股零股订单申报（HongKong Odd lot），零股订单也称可为**碎股**订单。

本业务产品集编号（setid）为：

107

数据广播类型（bcasttype），本业务取值：

成交回报和自动撤单回报:19

消息类型（MsgType），本业务取值：

8 = 申报响应或执行报告（Execution Report）

9 = 申报撤消失败（OrderCancelReject）

D = 申报（NewOrder Single）

F = 申报撤单（OrderCancel Request）

本业务有以下约定：

目前综合业务平台 STEP 撤单订单，均不分配交易所订单编号，因此撤单成功或失败响应中，交易所订单编号为空。

数据库中证券代码为港股代码，在基础信息文件 5 位港股代码基础上左补空格补齐 6 位。

港交所 OCG Binary 接口参见 Interface Specifications HKEx Orion Central Gateway Platform Binary Trading Protocol:

https://www.hkex.com.hk/services/trading/securities/infrastructure/overview?sc_lang=en

2 港股交易业务消息规范

2.1 港股交易业务 STEP 消息流程图

根据业务规则，市场投资者可以进行买卖申报和撤单申报，交易所实时反馈申报确认，并反馈成交回报（即执行报告）

下图描述了消息通信流程。



2.2 申报消息

NewOrderSingle (reqtext)	申报消息
<p>描述:</p> <p>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。</p> <p>市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行撮合买卖申报。支持以下请求业务申报：</p> <p>HKN（港股订单申报）</p> <p>HKO（港股零股订单申报）。</p> <p>注意其中订单价格、数量必须为非负数。</p>	

标签	字段名	字段描述	类型	
	消息头	MsgType 取值为: D=申报		
11	ClOrdID	会员内部编号, 指申报会员内部编号。	C10	
48	SecurityID	证券代码, 港股代码, 在基础信息文件 5 位代码基础上, 左补空格补齐 6 位	C6	
44	Price	价格, 单位港元。	N11(3)	
38	OrderQty	订单数量	N10	
54	Side	买卖方向, 取值有: 1 表示买 2 表示卖	C1	
40	OrdType	订单类型, 取值: 2 =限价 (Limit) 本字段对于零股无意义, 可取空格。	C1	
1090	MaxPriceLevels	最大价格等级, 取值: 1 表示竞价限价盘 0 为缺省值, 表示增强限价盘 本字段对于零股无意义, 可缺省取零。	N2	
59	TimeInForce	订单有效时间类型, 取值: 0 = 当日有效 (GFD), 即正常情况, 允许部分成交 4 = 即时全部成交否则撤销(FOK), 即不允许部分成交, 目前港股通订单暂不支持。	C1	
453	NoPartyIDs	参与方个数, 后接重复组, 依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号、营业部代码、结算代码, 取值为 4。	N2	
投资者账	448	PartyID	投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户	N4
申报交易单元	448	PartyID	业务 PBU 代码, 填写 5 位交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1, 表示当前 PartyID 的取值为 PBU	N4

营 业 部 代 码	448	PartyID	营业部代码	C5
	452	PartyRole	取 4001, 表示当前 PartyID 的取值为营业部代码	N4
结 算 代 码	448	PartyID	结算代码, 预留, 可取实际会员结算代码或默认值。	C5
	452	PartyRole	取 4, 表示当前 PartyID 的取值为结算代码	N4
58	Text		备注	C50

2.3 申报撤单消息

OrderCancel Request (reqtext)	申报撤单消息
<p>描述:</p> <p>请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。</p> <p>市场参与者使用 OrderCancel Request 消息进行申报撤单</p> <p>需要注意的是, 为简化会员公司备份切换动作, 综合业务平台采用原始申报的会员内部编号和业务交易单元号作为撤单索引字段。</p>	

标签	字段名	字段描述	类型	
	消息头	MsgType 取值为: F=申报撤单		
11	ClOrdID	会员内部编号, 指申报会员内部编号。	C10	
41	OrigClOrdID	原始交易客户方(券商)订单编号, 指示被撤消订单的 ClOrdID	C10	
48	SecurityID	证券代码	C6	
38	OrderQty	订单数量, 本业务不做校验	N10	
54	Side	买卖方向, 取值有: 1 表示买 2 表示卖	C1	
453	NoPartyIDs	参与方个数, 后接重复组, 依次包含投资者账户、申报交易单元号, 取值为 2。	N2	
发 起 方 投	448	PartyID	投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户	N4

发起方申报	448	PartyID	业务 PBU 代码，填写 5 位交易单元号，对于撤单，应为原始成交申报的业务 PBU 代码。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为 PBU	N4
58	Text		备注	C50

2.4 申报响应消息/申报撤单成功响应消息

ExecutionReport (resptext)	申报响应消息
<p>描述:</p> <p>请求及响应接口表中的 resptext 字段数据。</p> <p>每一个申报记录或申报撤单记录都分别有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理申报后返回的确认信息。</p> <p>启用 Text 字段记录港交所错误码以及错误描述。当 OrdRejReason 取值为 30000, 32000, 32002, 32004 以及 32006 时，Text 字段格式为“港交所错误码 港交所错误描述”。该信息仅供参考，详细错误说明请查阅港交所 OCG Binary 接口说明文档中的相关解释。</p> <p>150 和 39 组合取值含义:</p> <p>申报成功响应: 150=0, 39=0</p> <p>申报拒绝响应: 150=8, 39=8</p> <p>申报撤单成功响应: 150=6,39=6</p> <p>申报撤单失败响应: 参见 OrderCancelReject</p>	

标签	字段名	字段描述	类型
	消息头	MsgType 取值为: 8=申报响应	
37	OrderID	交易所订单编号	C16
150	ExecType	当前订单执行类型，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应	C1

		6=撤单成功 E=修改单成功	
39	OrdStatus	当前订单状态，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应 6=撤单成功 E=修改单成功	C1
48	SecurityID	证券代码	C6
11	CIOrdID	会员内部编号。	C10
60	TransactTime	接受请求时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
41	OrigCIOrdID	对于申报撤单成功响应，为原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤消/修改订单的 CIOrdID，对于申报响应，取值为空。	C10
103	OrdRejReason	对于申报响应，为申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。申报成功时，该字段取值为空。申报失败时，表示拒绝的理由，取值同 Remark 字段。 对于申报撤单成功响应，该字段取值为空。	C5
32	LastQty	对于申报撤单成功响应，为该撤单成功的数量。 其他无意义取 0	N12
58	Text	港交所错误信息	C50

2.5 申报撤单失败响应消息

OrderCancelReject (resptext)	申报撤单失败响应消息
<p>描述：</p> <p>请求及响应接口表中的 resptext 字段数据。</p> <p>启用 Text 字段记录港交所错误码以及错误描述。当 CxIRejReason 取值为 30000，32000，32002，32004 以及 32006 时，Text 字段格式为“港交所错误码 港交所错误描述”。该信息仅供参考，详细错误说明请查阅港交所 OCG Binary 接口说明文档中的相关解释。</p>	

标签	字段名	字段描述	类型
	标准消息头	MsgType 取值为： 9=申报撤消失效响应。	
37	OrderID	交易所订单编号	C16
39	OrdStatus	当前订单状态，取值有： 8=拒绝响应	C1
11	ClOrdID	会员内部编号。	C10
41	OrigClOrdID	原始交易客户方（券商）订单编号，指示被撤消订单的 ClOrdID	C10
60	TransactTime	接受请求时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
102	CxlRejReason	撤消失效时，撤单请求拒绝的理由，取值同 Remark 字段。 具体参见错误代码总表港股部分。	C5
434	CxlRejResponseTo	撤单响应类型，取值： 1=撤单响应	C1
58	Text	港交所错误信息	C50

2.6 执行报告消息

ExecutionReport (execreporttext)	实时执行报告消息
<p>描述：</p> <p>执行报告表中的 execreporttext 字段数据。</p> <p>对于香港交易所自动撤单，通过执行报告反馈撤单数据，成交数量为撤单数量，成交编号和成交金额取 0，订单执行状态、订单状态取值 4。</p> <p>启用 Text 字段记录港交所错误码以及错误描述。当 ExecType=4 时，Text 字段格式为“港交所错误码 港交所错误描述”。该信息仅供参考，详细错误说明请查阅港交所 OCG Binary 接口说明文档中的相关解释。</p>	

序号	字段名	字段描述	类型
	标准消息头	MsgType 取值为： 8=成交回报	
11	ClOrdID	会员内部编号，	C10

37	OrderID	交易所订单编号	C16	
17	ExecID	成交编号	C16	
1180	AppID	消息应用标识, 取值同数据库中请求业务类型 reqid	C3	
48	SecurityID	证券代码	C6	
31	LastPx	价格	N11(3)	
32	LastQty	该笔成交数量。	N12	
8504	TotalValueTraded	成交金额	N16(3)	
151	LeavesQty	本次剩余余额, 暂为 0	N12	
54	Side	买卖方向, 取值有: 1 表示买 2 表示卖	C1	
60	TransactTime	订单执行时间, 格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21	
42	OrigTime	原有订单请求接收的时间, 式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21	
150	ExecType	当前订单执行状态, 取值: F=成交 4=港股自动撤单 (Canceled)	C1	
39	OrdStatus	当前订单状态, 取值: 1=部分成交, 2=已成交, 4=已撤单	C1	
453	NoPartyIDs	参与方个数, 后接重复组, 依次包含发起方的投资者账户、申报交易单元号, 取值为 2。	N2	
投资者帐	448	PartyID	投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5, 表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户	N4
申报交易单	448	PartyID	业务 PBU 代码, 填写 5 位交易单元号	C5
	452	PartyRole	取 1, 表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号	N4
58	Text	港交所错误信息	C50	

3 过户数据接口 hghXXXXX.dbf

hghXXXXX.dbf	过户数据接口
<p>描述:</p> <p>文件名中 XXXXX 表示业务交易单元号。闭市后发送。</p> <p>未申明特别填写方式和单位的字段，均填写或参照对应订单输入时的原始信息，无意义字段不填。</p> <p>过户数据接口 hghXXXXX.dbf 压缩为 hghXXXXX.zip 文件中供下载。</p> <p>过户数据同实时成交回报。</p>	

序号	字段名	字段描述	类型
1	gddm	证券账户	C10
2	bcrq	成交日期，格式为 YYYYMMDD	C8
3	cjbh	成交编号	C16
4	gsdm	业务 PBU	C5
5	cjsl	成交数量	N12
6	zqdm	证券代码	C6
7	sbsj	申报时间，格式为 HHMMSS	C6
8	cjsj	成交时间，格式为 HHMMSS	C6
9	cjg	成交价格	N11(3)
10	cje	成交金额	N16(2)
11	sqbh	会员内部订单号，同申报接口中的 reff（会员内部订单号）	C10
12	cjbz	成交业务类型标志 HKN 港股订单申报（HongKong New entry） HKO 港股零股订单申报（HongKong Odd lot）	C3
13	bs	买卖方 B: 买	C1

		S: 卖	
14	text	备注，保留字段，暂不填	C30

4 港股通成交单据文件 tjss04XXXXX.txt

tjss04XXXXX.txt	港股通成交单据接口
<p>描述:</p> <p>文件名中 XXXXX 表示业务交易单元号。闭市后发送。</p> <p>本文件由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司生成，上交所转发。</p> <p>文件压缩为 tjss04XXXXX.zip（注意因工具限制，压缩后文件名缩短）文件中供下载。</p>	

序号	字段名	长度类型	字段说明
1	会员名称	C40	
2	证券代码	C6	
3	公司名称	C40	指证券名称
4	买卖方向	C1	B: 买, S: 卖
5	成交数量	N18 (3)	
6	成交价格	N10 (3)	单位为港元
7	成交金额	N19 (2)	单位为港元
8	印花税	N19 (2)	单位为港元
9	成交编号	N16	
10	成交日期	C8	YYYYMMDD 格式
11	制单日期	C8	YYYYMMDD 格式
12	交收日期	C8	YYYYMMDD 格式
13	说明 1	C80	此单据上的印花税款额，已经或将会通过香港联合交易所有限公司缴付
14	说明 2	C80	成交单据由上交所子公司根据联交所发送有关香港证券的成交结果予以制备及签立
15	说明 3	C80	上交所会员等机构委托上交所子公司将有关香港证券买卖订单路由至联交所进行及完成交易

5 港股实时行情 mkttdt04.txt (转发)

Mkttdt04.txt	港股行情文件接口
<p>描述:</p> <p>本文件为港股实时行情文件接口，行情文件名为 mkttdt04.txt，当日开市前至交易结束期间发送。本文件由港交所生成，表示港交所交易日产品行情，注意其中市场状态和证券交易状态代表港交所交易状态，并非港股通产品交易状态（参见交易盘实时状态接口文件）。当香港假期时，mkttdt04.txt 只含文件头及文件尾。</p> <p>本行情文件的使用和转发应遵守《上海证券交易所沪港通业务实施办法》及相关系统用户服务协议中的规定，详见本章附录。</p> <p>行情文件为文本 txt 文件，格式约定如下：</p> <ul style="list-style-type: none"> （一）竖线()为字段间分隔符，字段数据内容不应含有分隔符，有特殊说明的除外； （二）竖线()不应用在每条记录的开头和结尾； （三）各字段均为一个遵循格式定义的字符串，字段间有严格前后顺序； （四）字段定长，字段格式定义约定了长度和精度；字符型字段以 CX 格式表示，其中 X 代表字符串长度，不足部分左对齐，右补空格；整数数字型字段以 NX 格式表示，其中 X 代表数字型字符串长度，不足部分右对齐，左补空格；浮点数字型字段以 NX (Y) 格式表示，其中 X 代表数字型字符串总长度，Y 代表小数位数，X 包括一位小数点，整数部分最多不超过 X-Y-1 位，小数部分最多不超过 Y 位，不足部分右对齐，左补空格； （五）每行以十六进制 0x0A 结束，最后一行也以 0x0A 结束。 <p>文件描述:</p> <ul style="list-style-type: none"> （一）行情文件包含文件头、文件体、文件尾三个部分； （二）注意行情文件可扩展性，文件记录尾部可能随时增加扩展字段，接收处理方能向下兼容处理，即增加扩展字段后，对新增字段无需识别处理的用户，不需要升级系统；注意根据文件体首字段 MDSStreamID 取值解析不同的文件体记录形式； （三）文件体中，对于不同的行情数据类型，分别定义记录格式，接收处理方能根据行情数据类型识别处理；现时已定义的行情数据类型包括 MD401 - 港股通证券行情数据，MD404 - 港股通证券市调机制(VCM)信息，MD405 - 港股通证券收市竞价交易时段(CAS)信息及 MD406 - 港股通证券开市竞价交易时段(POS)数据； （四）文件体记录按证券代码递增； 	

Mktdt04.txt	港股行情文件接口
<p>(五) 文件中不包含暂停上市的股票，未开始上市交易的证券及摘牌后的证券；</p> <p>(六) 如文件中数值字段取值超过约定格式最大值，取最大值，如 N10 取 9999999999；</p> <p>(七) 前收盘价格，在开市之前即行发布。在盘中休市期间同样揭示各档买卖价格数量等全部信息；</p> <p>(八) 对于价格、金额数据，单位为港元。对于数量数据，单位为股(share)；</p> <p>(九) 在开市前或收市竞价交易时段内，如当时买卖盘可根据集合竞价算法达成参考平衡价格，申买价一和申卖价一将同时为参考平衡价格而申买量一和申卖量一则同时为当时的参考平衡成交量，如参考平衡价格未能达成，上述字段的含意与持续交易时段相同；</p> <p>(十) 字段无行情数据时，字符填充格，数值填 0；</p> <p>(十一) 字段无意义时，字符或数值均填充格；</p> <p>(十二) 在收盘后(市场状态为 0)，按盘价为收盘价格；</p> <p>(十三) 收盘价格一般于收盘后約 1 分钟前后发布；</p> <p>(十四) 在开盘集合竞价时段之前，除前收盘价格外，所有价格、金额、数量等行情数据均为 0；</p> <p>(十五) 文件体中，会先列出全部 MD401 的行情数据，再列出全部 MD404 的市调机制 (VCM) 信息(如适用)，再列出全部 MD406 的开市竞价交易时段 (POS) 信息(如适用)，最后列出全部 MD405 的收市竞价交易时段 (CAS) 信息(如适用)；</p> <p>(十六) MD404 数据文件体只会在当日交易时段内曾因 VCM 被触发而启动过冷静期之情况下出现。冷静期一经启动，MD404 数据文件体会持续发送此一冷静期的信息直至 (i) 同一证券于同日再次因 VCM 而进入另一冷静期，在此情况下，MD404 数据文件体将只发送该证券最新一次冷静期的信息；或 ((ii) Mktdt04.txt 的发送终止时间；</p> <p>(十七) MD405 数据文件体只包含 CAS 所涵盖的证券并只于 CAS 时段内发送。CAS 时段内 MD405 数据文件体会发送及更新各 CAS 证券的 CAS 参考价格及上下限价格。CAS 完结后 MD405 数据文件体会继续发送最后之 CAS 信息直至 Mktdt04.txt 的发送终止时间；</p> <p>(十八) 所有 CAS 证券及非 CAS 证券都会于 CAS 开始时定出参考价格，这些参考价格将于 MD401 行情数据文件体之按盘价栏发送。</p> <p>(十九) MD406 数据文件体只包含 POS 所涵盖的证券并只于 POS 时段内发送。POS 时段内 MD406 数据文件体会发送及更新各 POS 证券的 POS 参考价格及上下限价格。POS 完结后</p>	

Mktdt04.txt	港股行情文件接口
<p>MD406 数据文件体会停止发送；</p> <p>(二十) 所有 POS 证券都会于 POS 对盘前时开始发送参考价格；</p> <p>(二十一) 港交所具体证券代码，参见相关通知，并参考以上处理。</p>	

5.1 结构描述

结构图如下：



文件结构描述参考：

BeginString|Version|BodyLength|TotNumTradeReports|MDReportID|SenderCompID|MDTime|MDUpdateType|MktStatus

MDStreamID|SecurityID|Symbol|SymbolEn|TradeVolume|TotalValueTraded|PreClosePx|NominalPrice|HighPrice|LowPrice|TradePrice|BuyPrice1|BuyVolume1|SellPrice1|SellVolume1|SecTradingStatus|Timestamp

.....

.....

.....

EndString|Checksum

5.2 格式定义

文件头定义，第一行特殊记录：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	BeginString	起始标识符	C6	HEADER
2	Version	版本	C8	ITP1.00
3	BodyLength	数据长度	N10	计算出的长度字段分隔符后面的字节数（不包含本字段后面的分隔符），包含其他字段后面的分隔符、换行符。

				(暂不填写, 填空格)
4	TotNumTradeReports	文件体记录数	N5	文件体记录数
5	MDReportID	行情序号	N8	行情文件序号 (预留, 暂不填, 填空格)
6	SenderCompID	发送方	C6	发送方标示符, 取 XHKG01
7	MDTime	行情文件时间	C21	行情时间, 格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000 [为每次文件更新的时间, 不论是否盘中均要更新] 市场参与者系统注意根据此日期判断数据准确性, 避免误用测试数据。
8	MDUpdateType	发送方式	N1	0 = 快照 Full refresh 1 = 增量 Incremental (暂不支持)
9	MktStatus	市场状态	C8	0 = 全日收市 1 = 输入买卖盘(开盘集合竞价时段) 2 = 对盘(开盘集合竞价时段) 3 = 持续交易 4 = 对盘(收盘集合竞价时段) 5 = 输入买卖盘(收盘集合竞价时段) 7 = 暂停 100 = 未开市 101 = 不可取消 (开盘集合竞价时段) 102 = Exchange Intervention 103 = 收市 104 = 取消买卖盘 105 = 参考价定价(收盘集合竞价时段) 106 = 不可取消(收盘集合竞价时段) 107 = 随机收市(收盘集合竞价时段)

				108 = 随机对盘(开盘集合竞价时段) 注：请参阅附表有关各个市场状态的详细解释
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

文件体定义，多条行情记录，行情数据类型取值标识字母 MD 加类型编号。

当取值为 MD401 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	MDStreamID	行情数据类型	C5	行情数据类型标识符，取值 MD401 表示为港股通证券行情数据格式
2	SecurityID	证券代码	C5	证券代码，不足五位左补零。 例：00012 (对应 MMDH 定义域名：SecurityCode) 注：本接口中 MMDH 对应关系仅供参考。
3	Symbol	中文证券简称	C32	中文证券简称 [简体中文，最多 8 个汉字，UTF-16LE 编码（每个汉字编码可为 2 至 4 个字符）(注意汉字编码可能包含分隔符、换行符) (对应 MMDH 定义域名：SecurityNameGB)
4	SymbolEn	英文证券简称	C15	英文证券简称[最多 15 位] (对应 MMDH 定义域名：SecurityShortName)
5	TradeVolume	成交数量	N16	(对应 MMDH 定义域名：SharesTraded)
6	TotalValueTraded	成交金额	N16(3)	(对应 MMDH 定义域名：Turnover)
7	PreClosePx	昨日收盘价	N11(3)	(对应 MMDH 定义域名：PreviousClosingPrice)
8	NominalPrice	按盘价	N11(3)	收市竞价交易时段开始时为参考价格 收市后为收市价 其余时段为按盘价

				(对应 MMDH 定义域名: NominalPrice)
9	HighPrice	最高价	N11 (3)	全日最高价 (对应 MMDH 定义域名: HighPrice)
10	LowPrice	最低价	N11 (3)	全日最低价 (对应 MMDH 定义域名: LowPrice)
11	TradePrice	最新价	N11 (3)	最新成交价 (对应 MMDH 定义域名: LastPrice)
12	BuyPrice1	申买价一	N11 (3)	最佳买入价 集合竞价时段内, - 已有参考平衡价格(BuyPrice1 等于 SellPrice1 并为非零的情况下), 为参考平衡价格; - 未有参考平衡价格: 已有买盘, 为最佳买入价, 否则为零 (对应 MMDH 定义域名: BidPrice1)
13	BuyVolume1	申买量一	N12	最佳买入价的申买量 集合竞价时段内, - 已有参考平衡价格(BuyPrice1 等于 SellPrice1 并为非零的情况下), 为参考平衡成交量; - 未有参考平衡价格: 已有买盘, 为最佳买入价的申买量, 否则为零 (对应 MMDH 定义域名: AggregateBidQuantity1)
14	SellPrice1	申卖价一	N11 (3)	最佳卖出价 集合竞价时段内, - 已有参考平衡价格(BuyPrice1 等于 SellPrice1 并为非零的情况下), 为参考平衡价格; - 未有参考平衡价格: 已有卖盘, 为最佳卖出价, 否则为零 (对应 MMDH 定义域名: AskPrice1)

15	SellVolume1	申卖量一	N12	最佳卖出价的申卖量 集合竞价时段内， - 已有参考平衡价格(BuyPrice1 等于 SellPrice1 并为非零的情况下)，为参考平衡成交量； - 未有参考平衡价格：已有卖盘，为最佳卖出价的申卖量，否则为零 (对应 MMDH 定义域名：AggregateAskQuantity1)
16	SecTradingStatus	证券交易状态	C8	第 0 位：‘0’表示正常，‘1’表示暂停交易。 (对应 MMDH 定义域名：SecurityTradingStatus)
17	Timestamp	行情时间	C12	HH:MM:SS.000 为此证券行情最近的更新时间 一般盘前或当天收市价更新后，此更新时间固定不变。
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

当取值为 MD404 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	MDStreamID	行情数据类型	C5	行情数据类型标识符，取值 MD404 表示为港股通证券市调机制(VCM)数据格式 (只包含于交易时段内，因 VCM 被触发而启动冷静期之港股通证券的相关信息)
2	SecurityID	证券代码	C5	证券代码，不足五位左补零。 例：00012 (对应 MMDH 定义域名：SecurityCode)
3	Symbol	中文证券简称	C32	中文证券简称[简体中文，最多 8 个汉字，UTF-16LE 编码（每个汉字编码可为 2 至 4 个字符） (对应 MMDH 定义域名：SecurityNameGB)

4	SymbolEn	英文证券简称	C15	英文证券简称[最多 15 位]
5	VCMStartTime	市调机制开始时间	C8	VCM 冷静期开始的时间 HH:MM:SS (对应 MMDH 定义域名: CoolingOffStartTime)
6	VCMEndTime	市调机制结束时间	C8	VCM 冷静期结束的时间 HH:MM:SS (对应 MMDH 定义域名: CoolingOffEndTime)
7	VCMRefPrice	市调机制参考价	N11 (3)	VCM 冷静期内的参考价格-(对应 MMDH 定义域名: VCMReferencePrice)
8	VCMLowerPrice	市调机制下限价	N11 (3)	VCM 冷静期内的价格下限-(对应 MMDH 定义域名: VCMLowerPrice)
9	VCMUpperPrice	市调机制上限价	N11 (3)	VCM 冷静期内的价格上限-(对应 MMDH 定义域名: VCMUpperPrice)
10	Timestamp	行情时间	C12	HH:MM:SS.000 为此港股通证券 VCM 信息最近的更新时间
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

当取值为 MD405 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	MDStreamID	行情数据类型	C5	行情数据类型标识符，取值 MD405 表示为港股通证券收市竞价交易时段(CAS)数据格式 (于收市竞价交易时段开始发放及只包含 CAS 涵盖的港股通证券的相关信息)
2	SecurityID	证券代码	C5	证券代码, 不足五位左补零。 例: 00012 (对应 MMDH 定义域名: SecurityCode)
3	Symbol	中文证券简称	C32	中文证券简称[简体中文, 最多 8 个汉字, UTF-16LE 编码 (每个汉字编码可为 2 至 4 个字符)] (对应 MMDH 定义域名: SecurityNameGB)

4	SymbolEn	英文证券简称	C15	英文证券简称[最多 15 位]
5	CASRefPrice	收盘集合竞价时段参考价	N11(3)	CAS 的参考价格-(对应 MMDH 定义域名: ReferecePrice)
6	CASLowerPrice	收盘集合竞价时段下限价	N11(3)	CAS 的价格下限 (对应 MMDH 定义域名: LowerPrice)
7	CASUpperPrice	收盘集合竞价时段上限价	N11(3)	CAS 的价格上限 (对应 MMDH 定义域名: UpperPrice)
8	OrdImbDirection	不能配对买卖盘方向	C1	CAS 未能配对买卖盘的方向 N = 买卖盘量相等 B = 买盘比卖盘多 S = 卖盘比买盘多 <空格> = 不适用(未有参考平衡价格) (对应 MMDH 定义域名: OrderImbalanceDirection)
9	OrdImbQty	不能配对买卖盘量	N12	CAS 未能配对买卖盘的数量 (对应 MMDH 定义域名: OrderImbalanceQuantity)
10	Timestamp	行情时间	C12	HH:MM:SS.000 为此港股通证券收市竞价交易时段信息最近的更新时间 当天收市价更新后, 此更新时间固定不变。
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

当取值为 MD406 时, 文件体记录格式如下:

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	MDStreamID	行情数据类型	C5	行情数据类型标识符, 取值 MD406 表示为港股通证券开市竞价交易时段(POS)数据格式 (只于开市竞价交易时段发放及只包含 POS 涵盖的港股通证券的相关信息)

2	SecurityID	证券代码	C5	证券代码, 不足五位左补零。 例: 00012 (对应 MMDH 定义域名: SecurityCode)
3	Symbol	中文证券简称	C32	中文证券简称[简体中文, 最多 8 个汉字, UTF-16LE 编码 (每个汉字编码可为 2 至 4 个字符)] (对应 MMDH 定义域名: SecurityNameGB)
4	SymbolEn	英文证券简称	C15	英文证券简称[最多 15 位]
5	POSRefPrice	开盘集合竞价时段参考价	N11 (3)	POS 的参考价格, 于不可取消(开盘集合竞价时段)提供, 之前数值为 0 (对应 MMDH 定义域名: ReferecePrice)
6	POSLowerBidPrice	开盘集合竞价时段买盘下限价	N11 (3)	POS 买盘的价格下限 (对应 MMDH 定义域名: POSLowerPrice)
7	POSUpperBidPrice	开盘集合竞价时段买盘上限价	N11 (3)	POS 买盘的价格上限 (对应 MMDH 定义域名: UpperLimit / POSUpperLimit)
8	POSLowerAskPrice	开盘集合竞价时段卖盘下限价	N11 (3)	POS 卖盘的价格下限 (对应 MMDH 定义域名: LowerPrice / POSLowerPrice)
9	POSUpperAskPrice	开盘集合竞价时段卖盘上限价	N11 (3)	POS 卖盘的价格上限 (对应 MMDH 定义域名: POSUpperPrice)
10	OrdImbDirection	不能配对买卖盘方向	C1	POS 未能配对买卖盘的方向 N = 买卖盘量相等 B = 买盘比卖盘多 S = 卖盘比买盘多 <空格> = 不适用(未有参考平衡价格) (对应 MMDH 定义域名: OrderImbalanceDirection)
11	OrdImbQty	不能配对买卖盘量	N12	POS 未能配对买卖盘的数量 (对应 MMDH 定义域名:

				OrderImbalanceQuantity)
12	Timestamp	行情时间	C12	HH:MM:SS.000 为此港股通证券收市竞价交易时段信息最近的更新时间 当天收市价更新后，此更新时间固定不变。
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

文件尾定义，最后一行特殊记录：

		字段名	字段类型	描述
1	EndString	结束标识符	C7	TRAILER
2	Checksum	校验和	C3	<p>校验和，3位校验和</p> <p>校验和是通过计算不包括校验和字段（也不包括该字段后的换行符）数值的文件中其他每一个字符（包含分隔符、换行符）之和然后模 256 得出，然后转化为 3 位 ASCII 码。例如，如果经计算校验和为 274，则模 256 后的数为 18，校验和域将取为 ASCII 字符串 018</p> <p>校验和字段可用于开盘前和收盘后文件正确性校验。在实时交易期间，因文件按记录循环写入覆盖，校验和字段存在一定的概率与记录内容不匹配。</p>

附录一：市场状态取值说明

市场状态	描述
100 = 未开市	市场早晨开市前的状态，不含开盘集合竞价时段 (一般为 9:00 前)
1 = 输入买卖盘 (开盘集合竞价时段)	开盘集合竞价时段，竞价盘下单时的状态 (一般为 9:00 至 9:15)
101 = 不可取消 (开盘集合竞价时段)	开盘集合竞价时段暂停订单取消或修改的状态 (一般为 9:15 至 9:20)
108 = 随机对盘 (开盘集合竞价时段)	开盘集合竞价时段，于 9:20 开始后 2 分钟期间随机收盘时的状态 (一般为 9:20 至 9:22)
2 = 对盘 (开盘集合竞价时段)	开盘集合竞价时段，竞价盘配对时的状态 (一般为 9:20 至 9:22，紧接随机对盘后)
7 = 暂停	开盘集合竞价时段结束后，至全市场开市前的状态。此时段暂停任何下单及交易活动 (一般为 9:22 至 9:30，紧接对盘后)
3 = 持续交易	全市场处于交易期间，不含开盘集合竞价时段(市场状态为 1、101、2、7 和 102)及中间休市时段(市场状态为 103)及下午开市前订单取消时段(市场状态为 104) (一般 9:30 至 12:00 及 13:00 至 16:00)
102 = Exchange Intervention	交易所介入时段，暂停任何下单及交易活动 (一般为 12:00 至 12:05 及 16:00 至 16:01)
103 = 收市	中间休市时段 (一般为 12:05 至 12:30)
104 = 取消买卖盘	下午开市前订单取消时段 (一般为 12:30 至 13:00)
105 = 参考价定价 (收盘集合竞价时段)	收盘集合竞价时段，计算及公布参考价时的状态 (一般为 16:00 至 16:01)
5 = 输入买卖盘	收盘集合竞价时段，竞价盘下单时的状态

(收盘集合竞价时段)	(一般为 16:01 至 16:06)
106 = 不可取消 (收盘集合竞价时段)	收盘集合竞价时段，暂停订单取消或修改的状态 (一般为 16:06 至 16:08)
107 = 随机收市 (收盘集合竞价时段)	收盘集合竞价时段，于 16:08 开始后 2 分钟期间随机收盘时的状态 (一般为 16:08 至 16:10)
4 = 对盘 (收盘集合竞价时段)	收盘集合竞价时段，竞价盘配对时的状态 (一般为 16:08 至 16:10，紧接随机收市后)
0 = 全日收市	全市场处于闭市期间，收盘集合竞价时段结束后的状态 (一般为 16:10 后)

附录二：港股相关交易信息用户约束

未获得上海证券交易所港股通资格之会员及其他机构不得订阅或接收本所提供的香港联合交易所有限公司（简称“联交所”）发布的交易信息（简称“联交所交易信息”）。已获得上海证券交易所港股通资格之会员及其他机构收到本所提供的联交所交易信息后，仅可用于通过行情信息终端对联交所交易信息进行内部展示、行情查看、研究分析等自用途，不得以任何方式提供给其他机构和个人使用或者予以传播，也不得用于开发指数或者其他产品。如果已获得上海证券交易所港股通资格者系上海证券交易所会员，该会员可将联交所交易信息转发给其客户，或在其网上交易系统的信息终端等平台中向客户提供，但必须保证该客户为最终用户，且该最终用户亦仅可将联交所交易信息用于：通过行情信息终端进行内部展示、行情查看、研究分析等自用途，不得以任何方式提供给其他机构和个人使用或者予以传播，也不得用于开发指数或者其他产品。

6 港股通交易盘实时状态 trdses04.txt

trdses04.txt	港股通交易盘实时状态
<p>描述:</p> <p>本文件为港股通交易盘实时状态文件接口。文件名为 trdses04.txt (TradingSessionStatus)，当日开市前至交易结束期间，通过交易所行情信道定时发送。</p> <p>文件为文本 txt 文件，约定同 mkttdt04.txt 行情文件。</p> <p>文件描述:</p> <p>(一) 同 mkttdt04.txt 文件结构，文件包含文件头、文件体、文件尾三个部分；</p> <p>(二) 注意文件可扩展性，文件记录尾部可能随时增加扩展字段，接收处理方应能向下兼容处理，即增加扩展字段后，对新增字段无需识别处理的用户，不需要升级系统；</p> <p>(三) 文件体中，对于不同的数据类型，分别定义记录格式，接收处理方应根据数据类型识别处理；</p> <p>(四) 注意本文件中市场状态和证券交易状态不同于港股行情 mkttdt04.txt 中相关状态，mkttdt04.txt 指港交所对外发布的实时行情，而本文件中相关状态指上交所对港股通订单的额外控制，用于先行控制向上交所的订单申报，后续转发至港交所是否接受，则根据港股行情状态由港交所控制。如其中一种场景是：当港交所正常开市交易，但港股通限制交易时，mkttdt04.txt 证券交易状态正常，而本接口证券交易状态有限制。</p> <p>(五) 本文件目前包含额度和港股通交易状态数据，并可扩展内容。</p>	

6.1 格式定义

文件头定义，第一行特殊记录：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	BeginString	起始标识符	C6	HEADER
2	Version	版本	C8	ITP1.00
3	BodyLength	数据长度	N10	计算出的长度字段分隔符后面的字节数（不包含本字段后面的分隔符），包含其他字段后面的分隔符、换行符。 (暂不填写，填空格)
4	TotNumTradeReports	文件体记录数	N5	文件体记录数
5	MDReportID	序号	N8	文件序号（预留，填空格）
6	SenderComp	发送方	C6	发送方标示符，取

	ID			XSHG01
7	MDTime	时间	C21	时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000 [为每次文件更新的时间]
8	MDUpdateType	发送方式	N1	0 = 快照 Full refresh 1 = 增量 Incremental (暂不支持)
9	MktStatus	市场状态	C8	该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。 第 1 位：‘0’ 表示全市场限制买入，‘1’ 表示正常无此限制。 第 2 位：‘0’ 表示全市场限制卖出，‘1’ 表示正常无此限制。 第 3 位：‘0’ 表示当日非港股通交易日，‘1’ 表示当日港股通交易日。
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

文件体定义，一个文件中包含多结构数据，数据类型取值标识字母 MD 加类型编号。

当取值为 MD402 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	MStreamID	数据类型	C5	数据类型标识符，取值 MD402 表示港股通实时额度数据格式类型
2	ThresholdAmount	每日初始额度	N13	每日初始额度，单位人民币元
3	PosAmt	日中剩余额度	N13	日中剩余额度，单位人民币元 具体计算方法以交易所相关规则为准。
4	AmountStatus	额度状态	C1	额度状态 1: 额度用完或其他原因全市场禁止买入； 2: 额度可用。

		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。
--	--	------	----	-------------------

当取值为 MD403 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	MDStreamID	数据类型	C5	数据类型标识符，取值 MD403 表示上交所港股通可接收订单并转发的产品状态数据。
2	SecurityID	证券代码	C5	证券代码，不足五位左补零。 例：00012
3	SecTradingStatus1	证券交易状态 (港股整手订单)	C8	该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。 第 1 位：‘0’ 表示限制买入，‘1’ 表示正常无此限制。 第 2 位：‘0’ 表示限制卖出，‘1’ 表示正常无此限制。
4	SecTradingStatus2	证券交易状态 (港股零股订单)	C8	该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。 第 1 位：‘0’ 表示限制买入，‘1’ 表示正常无此限制。 第 2 位：‘0’ 表示限制卖出，‘1’ 表示正常无此限制。
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

文件尾定义，最后一行特殊记录：

		字段名	字段类型	描述
1	EndString	结束标识符	C7	TRAILER
2	CheckSum	校验和	C3	校验和，3 位校验和 校验和是通过计算不包括校验和字段(也不包括该字段后的换行符)数值的文

				<p>件中其他每一个字符（包含分隔符、换行符）之和然后模 256 得出，然后转化为 3 位 ASCII 码。例如，如果经计算校验和为 274，则模 256 后的数为 18，校验和域将取为 ASCII 字符串 018</p> <p>校验和字段可用于开盘前和收盘后文件正确性校验。在实时交易期间，因文件按记录循环写入覆盖，校验和字段存在一定的概率与记录内容不匹配。</p>
--	--	--	--	--

7 港股基础信息 reff04MMDD.txt (转发)

reff04MMDD.txt	港股基础信息接口
<p>描述:</p> <p>文件名中 MMDD 表示月日格式的文件适用日期, 在交易日开市前发送。</p> <p>该接口文件说明港股产品的相关信息, 包含适用日期所有港股产品的基础信息数据。</p> <p>时间和频率: 每个交易日开市前发送</p> <p>数据格式: 记录采用行格式, 字段以分隔符' '来区分, 固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式, 即通过 0x0A 表示换行。</p> <p>本文件由港交所生成, 上交所转发。</p> <p>关于前收盘价格字段约定如下:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1.前收盘价格字段为(交易日)除权(息)后收盘价。 2.若 T 日停牌产品, T 日收到的本文件该产品的“前收盘价格”为 T-1 (交易日)本文件中该产品的“前收盘价格”的除权(息)价(若 T 日当天发生除权(息)事项), 若 T+1 日夜停盘, 则依次递推。 3.摘牌产品, 本文件不含该证券数据。 4. 证券面值于香港结算系统中长度及格式: 整数位为 8(包括小数点)及小数位为 5 (Round up) 。在一般情况下, 如该证券之实际面值少于小数点后 5 位数例如 0.000003, 该证券面值会输入为最低数值 0.00001 或 0。 5. 因应公司行动(例如合并, 分拆等), 证券面值及证券面值货币种类会于行动生效日(交易日)早上更改并反映在此文件数据中。临时代码产品信息数据会包含于本文件中。 	

文件记录定义:

当参考数据类型取值为 R0401 时, 文件记录格式如下, 有多条记录:

序号	域名	字段名	长度	字段描述
1.	RFSreamID	参考数据类型	C5	R0401
2.	SecurityID	证券代码	C5	证券代码, 不足五位左补零。 例: 00012
3.	ISIN	ISIN 代码	C12	ISIN 代码(例: HK0000000012) 若该证券没有 ISIN 代码则填空。

4.	Symbol	中文证券简称	C40	证券名称 (简体中文, 最多 8 个汉字, GBK 编码)
5.	SymbolEn	英文证券简称	C15	英文证券简称
6.	SecurityDesc	英文全称	C40	英文证券全称
7.	UnderlyingSecurityID	辅助证券代码	C5	权证的正股代码
8.	MarketID	市场种类	C4	MAIN- 主板 GEM-创业板 ETS-扩充交易证券 NASD-Nasdaq AMX 市场
9.	SecurityType	证券类别	C4	BOND Bond 债券 BWRT Basket Warrant 一篮子权证 EQTY Equity 股本 TRST Trust 信托 WRNT Warrant 权证
10.	Currency	货币种类	C3	港币: HKD; 美元: USD; 人民币: CNY; 澳 币: AUD; 加币: CAD; 日圆: JPY; 新加坡 币: SGD; 英镑: GBP; 欧元: EUR
11.	AmountTimes	货币单位	C1	货币单位表示前收盘价格字段的单位, 当货币 单位取值为 0 时, 前收盘价格=前收盘价格字段 取值×10 的 0 次幂, 当货币单位取值为 1 时, 前收盘价格=前收盘价格字段取值×10 的 1 次 幂, 依次类推。
12.	PerValue	面值	N15(8)	股票的面值, 若无面值, 则为 0。单位是元。 整数位不超过 6 位。
13.	PerValue Currency	面值货币种类	C3	港币: HKD; 美元: USD; 人民币: CNY 若该产品无面值, 则该字段为空。
14.	Interest	利息	N15(8)	对于债券填写交收日利息 仅针对利息通过 CCASS 系统来结算的债 券, 其他情况该字段为 0.

15.	IssueDate	上市日期	C8	在港交所首日交易日期，YYYYMMDD
16.	RoundLot	买卖单位	N6	整手数 买卖申报数量必须是该字段的整数倍。
17.	PreClosePx	前收盘价格	N10(3)	当日除权（息）后收盘价格 （如有除权除息，为除权除息后收盘价）
18.	Text	备注	C50	第一位有效 Y 表示停牌 N 表示非停牌 第二位有效 Y 表示参与市场波动调节机制 N 表示不参与 第三位有效 Y 表示参与收市竞价交易时段 N 表示不参与 第四位有效 Y 表示参与开市前时段优化 N 表示不参与 第五至六位有效 价差代码, 不足两位左补零 第七至八位有效 市场波动调节机制类别 预留，暂无数据。 备注的后续字节为保留字段，无效
19.	SecurityStatusFlag	产品状态信息	C8	该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。 第 1 位：无定义。 第 2 位：无定义。 第 3 位：‘0’ 表示非标的证券，‘1’ 表示标的证券。
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

8 港股通参考汇率文件 extra04MMDD.txt（转发）

extra04MMDD.txt	港股通参考汇率接口
<p>描述：</p> <p>文件名中 MMDD 表示月日格式的文件适用日期，在交易日开市前发送。</p> <p>数据格式：记录采用行格式，字段以分隔符' '来区分，固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式，即通过 0x0A 表示换行。</p> <p>本文件由 中国证券登记结算有限责任公司 上海分公司生成，上交所转发。</p> <p>本文件为港股通交易日额度控制的预估汇率。</p> <p>本文件所有汇率均为一元外币兑换人民币价格。</p>	

序号	字段名	长度	字段描述
1	参考数据类型	C5	Q0402
2	参考汇率买入价	N15(5)	
3	参考汇率卖出价	N15(5)	
4	参考汇率中间价	N15(5)	保留
4	货币种类	C3	HKD 港币
5	适用日期	C8	YYYYMMDD
6	备用	C20	

9 最小价差文件 zxcMMDD.txt (转发)

zxcMMDD.txt	最小价差文件
<p>描述:</p> <p>文件名中 MMDD 表示月日格式的文件适用日期, 在交易日开市前发送。</p> <p>数据格式: 记录采用行格式, 字段以分隔符' '来区分, 固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式, 即通过 0x0A 表示换行。</p> <p>本文件由港交所生成, 上交所转发。</p>	

序号	字段名	长度	字段描述
1.	参考数据类型	C5	R0403
2.	价差表代码	C2	价差代码, 不足兩位左补零。 例: 01 - 股本证券 02 - 債務证券 03 - 股票期权
3.	最低下限价格	N10(3)	本价差表代码容许的最低成交价格
4.	最高上限价格	N10(3)	本价差表代码容许的最高成交价格
5.	起点价格	N10(3)	本价差表代码的最小价格
6.	价差組別数量	N2	以下为本价差表有的实际价差組別数量 (数量值由 1 到 52)
7.	价差組別: (重复共 52 组)		
7a	組別终点价格	N10(3)	本价差組別的最高价格 当組別数大过价差組別数量时, 取值为 000000.000
7b	价差值	N6(3)	价差值是上一个組別终点价格(若第一个組別则为起点价格)與今个組別终点价格之間的价差(例: 12.456) 当組別数大过价差組別数量时, 取值为 00.000
7c	价差数量	N6	本价差組別的价格差数量

		当组别数大过价差组别数量时，取值为 000000
--	--	--------------------------

10 后记

上海证券交易所对本文档享有知识产权，未经上海证券交易所书面许可，任何单位和个人不得将本文档用于其他商业目的。

对本文档有任何批评指正意见，请发电子邮件到 tech_support@sse.com.cn 或者致电 4009003600。